

PRINCIPAL DEUDA 1, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			179,942,524	8.09 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	68,525,475	3.08 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	55,389,273	2.49 %
IS	BPA182	190411	AAA(mex)	40,919,658	1.84 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	15,108,119	0.68 %
	Bondes D			275,138,457	12.37 %
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	120,014,778	5.40 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	70,109,477	3.15 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	69,965,757	3.15 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	15,048,445	0.68 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			601,030,384	27.02 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	104,064,153	4.68 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	96,009,415	4.32 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	91,359,748	4.11 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	80,234,938	3.61 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	72,999,194	3.28 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	65,530,694	2.95 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	50,338,487	2.26 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	40,493,756	1.82 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			245,255,630	11.03 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	115,229,087	5.18 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	69,960,756	3.15 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	50,068,833	2.25 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	9,996,955	0.45 %
	Cetes			259,389,507	11.66 %
BI	CETES	171221	AAA(mex)	68,213,754	3.07 %
BI	CETES	180621	AAA(mex)	56,468,454	2.54 %
BI	CETES	171109	AAA(mex)	38,010,043	1.71 %
BI	CETES	171123	AAA(mex)	34,293,144	1.54 %
BI	CETES	180104	AAA(mex)	34,016,150	1.53 %
BI	CETES	180524	AAA(mex)	28,387,962	1.28 %
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			20,060,721	0.90 %
JI	CABEI	1-16	AAA(mex)	20,060,721	0.90 %
	Udibonos UDIS			310,105,595	13.94 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	83,266,978	3.74 %
S	UDIBONO	171214	AAA(mex)	69,874,037	3.14 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	65,453,944	2.94 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	35,243,630	1.58 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	30,362,225	1.36 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	25,904,782	1.16 %
	Valores paraestatales Rendim.			189,343,865	8.51 %
95	CFE	14	Aa1.mx	45,023,044	2.02 %
95	PEMEX	12	Aa3.mx	27,061,332	1.22 %
95	FEFA	17-2	AAA(mex)	22,189,389	1.00 %
95	FEFA	17	AAA(mex)	22,149,692	1.00 %
95	CEDEVIS	0810U	AAA(mex)	21,019,258	0.94 %
95	PEMEX	14	Aa3.mx	19,864,131	0.89 %
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	14,542,185	0.65 %
95	CFE	15	Aa1.mx	7,715,902	0.35 %
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	5,666,119	0.25 %
95	FEFA	17-4	AAA(mex)	4,112,815	0.18 %
	Reportos			144,209,591	6.48 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	60,011,669	2.70 %
LD	BONDESD	210121	AAA(mex)	57,975,918	2.61 %
LD	BONDESD	170824	AAA(mex)	24,186,254	1.09 %
LD	BONDESD	200924	AAA(mex)	2,035,750	0.09 %
	TOTAL CARTERA			2,224,476,273	100.00 %
	ACTIVO NETO			2,213,500,861	
	VAR ESTABLECIDO \$			8,411,303	0.38 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			717,112	0.03 %
	Cartera al:		8/10/2017		

EL VALOR EN RIESGO (VAR POR SUS SIGLAS EN INGLÉS) ES CALCULADO UTILIZANDO EL MÉTODO MONTECARLO, CONSIDERANDO 250 PERÍODOS DE HISTORIA Y GENERANDO 1000 ESCENARIOS DE LOS PRINCIPALES FACTORES DE RIESGO QUE AFECTAN EL VALOR DE LOS ACTIVOS QUE COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS